

МВА «ФИНАНСОВЫЙ РИСК - МЕНЕДЖМЕНТ И DATA SCIENCE»

ПРОГРАММА ОБУЧЕНИЯ

Модуль "Data Science":

1. Статистика (продвинутый уровень)
2. Анализ временных рядов
3. Предиктивная аналитика
4. Принципы программирования 1
5. Принципы программирования 2
6. Машинное обучение

Модуль "Управление рисками":

7. Финансовые рынки и инструменты
8. Финансовый риск-менеджмент и модели оценки рисков
9. Портфельный менеджмент
10. Кредитный риск-менеджмент
11. Управление операционными рисками
12. Управление риском ликвидности финансовых институтов
13. Технологии сценарного анализа и стресс-тестирования в принятии управленческих решений
14. Методология проектного управления

Модуль "Экономическая среда управления рисками"

15. Корпоративные финансы
16. Современные теории финансовых рынков
17. Финансовый учет и анализ

Обязательный компонент (по требованиям МНиВО РК):

18. Стратегический менеджмент
19. Бизнес-исследование
20. Экспериментально-исследовательская работа
21. Производственная практика
22. Итоговая аттестация (защита магистерского проекта)

РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ (КОМПЕТЕНЦИИ)

✓ Управление рисками с учетом лучших практик и концептуальных подходов в контексте различных сценариев развития экономической среды.

✓ Разработка сценариев реализации прогнозируемых рисков для проведения стресс-тестирования устойчивости бизнес-модели и эффективности финансово-инвестиционных решений компании.

✓ Моделирование и прогнозирование рисков с применением инструментов фундаментальной аналитики, эконометрического моделирования и машинного обучения.

✓ Адаптация технологий искусственного интеллекта для автоматизации процессов управления рисками.

✓ Развитие системы риск-менеджмента на принципах проектного управления.

Қаржылық тәуекел-менеджмент және Data Science (MBA)

ОҚЫТУ БАҒДАРЛАМАСЫ

"Data Science" Модулі:

1. Статистика (жоғары деңгей)
2. Уақыт қатарларын талдау
3. Болжалды аналитика
4. Бағдарламалау принциптері 1
5. Бағдарламалау принциптері 2
6. Машиналық оқыту

"Тәуекелдерді басқару" модулі:

7. Қаржы нарықтары мен құралдары
8. Қаржылық тәуекел-менеджмент және тәуекелдерді бағалау модельдері
9. Портфельді басқару
10. Несиелік тәуекелдерді басқару
11. Операциялық тәуекелдерді басқару
12. Қаржы институттарының өтімділік тәуекелін басқару
13. Басқару шешімдерін қабылдаудағы сценарийлік талдау және стресс-тестілеу технологиялары
14. Жобалық басқару әдістемесі

"Тәуекелдерді басқарудың экономикалық ортасы" модулі:

15. Корпоративтік қаржы
16. Қаржы нарықтарының қазіргі теориялары
17. Қаржылық есеп және талдау

Міндетті компонент (ҚР ҒЖЖБМ талаптары бойынша):

18. Стратегиялық менеджмент
19. Бизнесі зерттеу
20. Экспериментті-зерттеу жұмысы
21. Өндірістік практика
22. Қорытынды аттестаттау (магистрлік жобаны қорғау)

ОҚЫТУ НӘТИЖЕЛЕРІ (ҚҰЗЫРЕТТЕР)

✓ Экономикалық ортаны дамытудың әртүрлі сценарийлері контекстіндегі ең жақсы тәжірибелер мен тұжырымдамалық тәсілдерді ескере отырып, тәуекелдерді басқару.

✓ Бизнес-модельдің тұрақтылығы мен компанияның қаржылық-инвестициялық шешімдерінің тиімділігіне стресс-тестілеу жүргізу үшін болжамды тәуекелдерді іске асыру сценарийлерін әзірлеу.

✓ Іргелі аналитика, эконометрикалық модельдеу және машиналық оқыту құралдарын қолдана отырып, тәуекелдерді модельдеу және болжау.

✓ Тәуекелдерді басқару процестерін автоматтандыру үшін жасанды интеллект технологияларын бейімдеу.

✓ Жобаны басқару қағидаттарында тәуекел-менеджмент жүйесін дамыту.